

德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF） 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：德邦基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 08 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 3 月 24 日起至 2017 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 15 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| §7 投资组合报告..... | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 43 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 43 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 47 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 50 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 50 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 50 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 50 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 50 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 50 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 51 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 51 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 52 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 52 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 52 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 52 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 53 |
| §10 重大事件揭示..... | 54 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 54 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 54 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 54 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 54 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 54 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 54 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 54 |
| 10.8 其他重大事件..... | 56 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 58 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况..... | 58 |

| | |
|-------------------------|-----------|
| §12 备查文件目录 | 59 |
| 12.1 备查文件目录..... | 59 |
| 12.2 存放地点..... | 59 |
| 12.3 查阅方式..... | 59 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|----------------------|-----------------|
| 基金名称 | 德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF） | |
| 基金简称 | 德邦量化优选股票（LOF） | |
| 基金主代码 | 167702 | |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式（LOF） | |
| 基金合同生效日 | 2017 年 3 月 24 日 | |
| 基金管理人 | 德邦基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 国泰君安证券股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 64,941,591.04 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 量化优选 | 优选 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 167702 | 167703 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 11,704,519.54 份 | 53,237,071.50 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在力求严格控制投资风险的前提下，通过数量化的方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金通过资股票投资、固定收益投资、衍生品投资、中小企业私募债券投资、资产支持证券的投资、国债期货投资等多方面进行全面分析，调整投资组合配置。 |
| 业绩比较基准 | 95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|---------------|-----------------------|
| 名称 | 德邦基金管理有限公司 | 国泰君安证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李定荣 |
| | 联系电话 | 021-26010999 |
| | 电子邮箱 | service@dbfund.com.cn |
| 客户服务电话 | 4008217788 | 95521 |
| 传真 | 021-26010808 | 021-38677819 |
| 注册地址 | 上海市虹口区吴淞路 218 | 中国（上海）自由贸易试验区商 |

| | | |
|-------|-------------------------------|--------------------------|
| | 号宝矿国际大厦 35 层 | 城路 618 号 |
| 办公地址 | 上海市虹口区吴淞路 218 号宝矿国际大厦 35 层 | 上海市浦东新区银城中路 68 号 32 层 |
| 邮政编码 | 200080 | 200120 |
| 法定代表人 | 姚文平 | 杨德红 |

2.4 信息披露方式

| | |
|--------------------------|-----------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 《证券日报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址 | www.dbfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------------------|------------------------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京西城区太平桥大街 17 号 |
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通 合伙） | 上海市浦东新区世纪大道 100 号上 海环球金融中心 50 楼 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别 | 量化优选 | 优选 C |
|---------------|------------------------------|------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2017年3月24日 - 2017年6月30日) | 报告期(2017年3月24日 - 2017年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 86,800.92 | -300,046.66 |
| 本期利润 | 703,963.86 | 2,291,173.66 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0359 | 0.0301 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.61% | 3.04% |
| 本期基金份额净值增长率 | 5.45% | 5.21% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 14,263.04 | -55,482.61 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0012 | -0.0010 |
| 期末基金资产净值 | 12,342,234.43 | 56,011,703.53 |
| 期末基金份额净值 | 1.0545 | 1.0521 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2017年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 5.45% | 5.21% |

注：1、本基金合同生效日为2017年3月24日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未
满一年。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相
关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为
期末余额，不是当期发生数）。

4、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水
平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

量化优选

| 阶段 | 份额净值增 长率① | 份额净值 增长率标 准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 6.70% | 0.61% | 4.73% | 0.64% | 1.97% | -0.03% |

| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 过去三个月 | 5.24% | 0.59% | 5.80% | 0.59% | -0.56% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.45% | 0.56% | 4.84% | 0.58% | 0.61% | -0.02% |

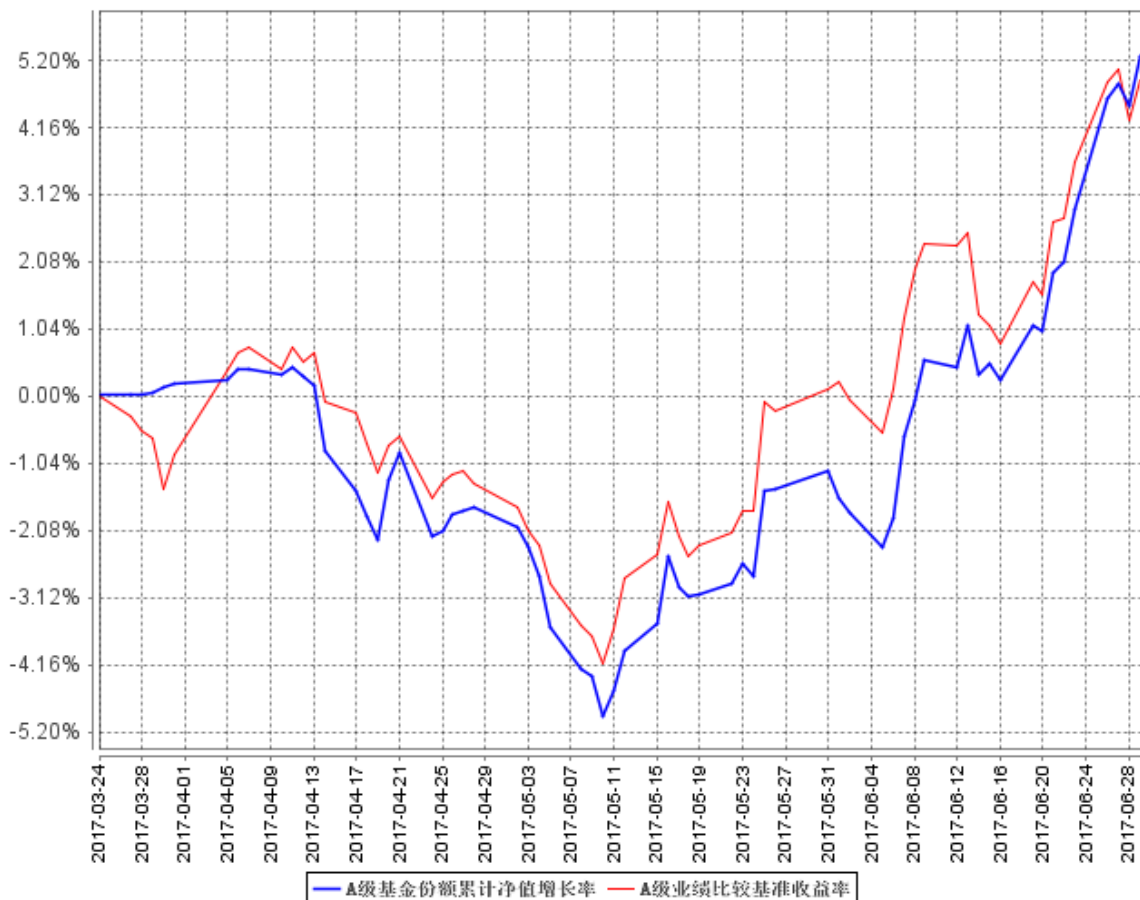
优选 C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 6.66% | 0.61% | 4.73% | 0.64% | 1.93% | -0.03% |
| 过去三个月 | 5.08% | 0.58% | 5.80% | 0.59% | -0.72% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.21% | 0.56% | 4.84% | 0.58% | 0.37% | -0.02% |

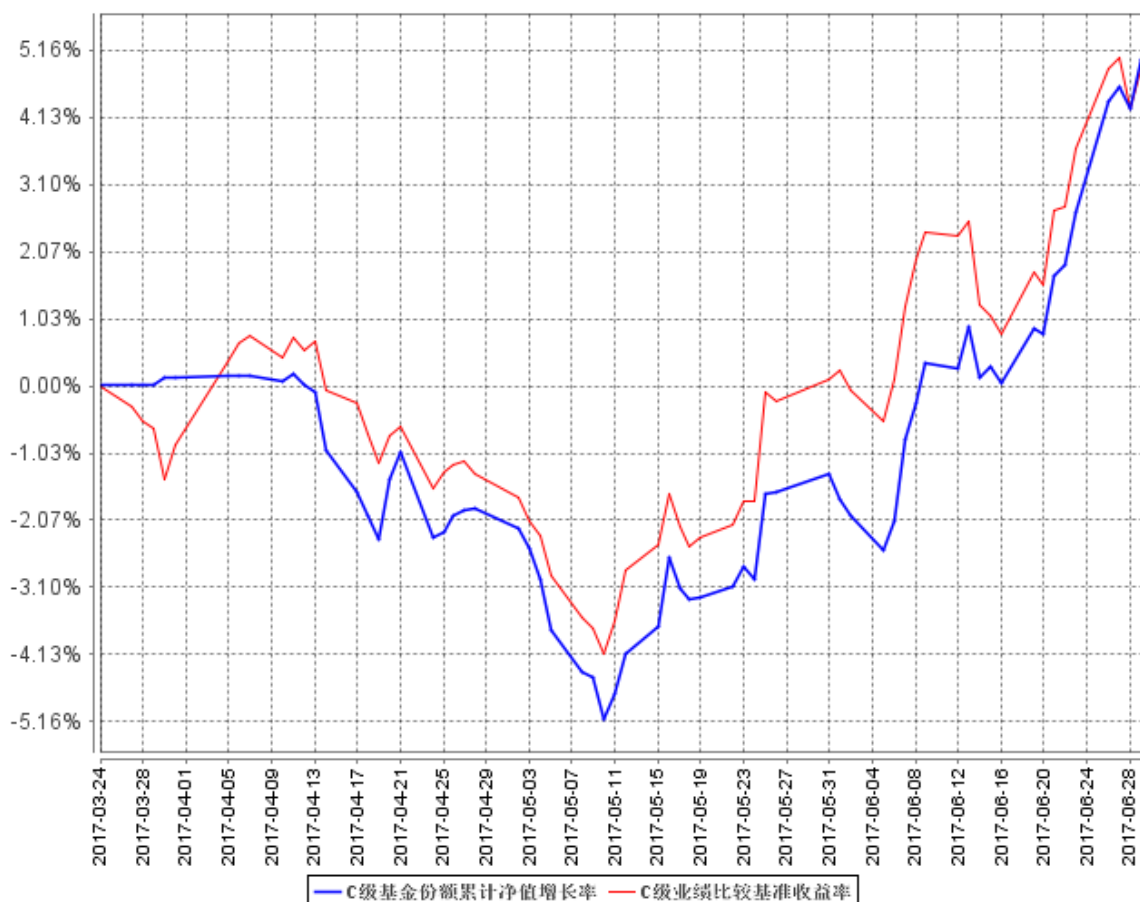
注：本基金业绩比较基准：95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2017 年 3 月 24 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满 1 年。本基金的建仓期为 6 个月，自 2017 年 3 月 24 日合同生效日起至 2017 年 06 月 30 日，本基金运作时间未满 6 个月，仍处于建仓期中。图示日期为 2017 年 3 月 24 日至 2017 年 06 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

德邦基金管理有限公司经中国证监会（证监许可[2012]249号）批准，于2012年3月27日正式成立。股东为德邦证券股份有限公司、西子联合控股有限公司、浙江省土产畜产进出口集团有限公司，注册资本为2亿元人民币。公司以修身、齐家、立业、助天下为己任，秉持长期的价值投资理念，坚守严谨的风险控制底线，致力于增加客户财富，为客户提供卓越的理财服务。

截止2017年6月30日，本基金管理人共管理二十四只开放式基金：德邦多元回报灵活配置混合型证券投资基金、德邦如意货币市场基金、德邦纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、德邦纯债一年定期开放债券型证券投资基金、德邦景颐债券型证券投资基金、德邦德焕9个月定期开放债券型证券投资基金、德邦德景一年定期开放债券型证券投资基金、德邦现金宝交易型货币市场基金、德邦锐璟债券型证券投资基金、德邦增利货币市场基金、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金、德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金（LOF）、德邦德利货币市场基金、德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星稳健灵活配置混合型证券投资基金、德邦新添利债券型证券投资基金、德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金、德邦锐乾债券型证券投资基金、德邦群利债券型证券投资基金、德邦稳盈增长灵活配置混合型证券投资基金、德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）和德邦锐祺债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------------------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王本昌 | 金融工程与量化投资部总监兼任组合基金投资部总监、本 | 2017年3月24日 | - | 13年 | 硕士，曾任华泰柏瑞基金管理有限公司研究部高级数量分析师、投资部基金经理助理、基金经理、量化投资部基金经理；塔塔咨询服务有限公司业务分析师；济安金信科技有限公司金融工程师；济安陆 |

| | | | | |
|--|------------------|--|--|---|
| | 基金的 基金经 理。 | | | 平投资管理有限公司金融 工程师。2015 年 8 月加入 德邦基金，现任公司金融 工程与量化投资部总监兼 任组合基金投资部总监、 基金经理。 |
|--|------------------|--|--|---|

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度规定，对投资交易行为进行监察稽核，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，借助 IT 系统和人工监控等方式在各个环节严格控制交易公平执行；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并对连续连两个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证

券当日成交量的 5%的情况，且未发现其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，A 股市场呈现出以“行业龙头”、“消费白马股”领涨的市场结构行情，市场的主流投资逻辑也开始向价值为核心进行转变。本基金以一贯坚持的基本面选股为基础，通过动态多因子选股模型进行产品的稳步建仓。此报告期内，在以上证 50 为代表的大盘股强势的行情下，本基金依然取得较为不错的业绩表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末量化优选基金份额净值为 1.0545 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.45%；截至本报告期末优选 C 基金份额净值为 1.0521 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.21%；同期业绩比较基准收益率为 4.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金认为，从货币政策角度来看，自去年下半年以来的“去杠杆”、“紧平衡”的货币政策的短期目标已有所达成，所谓的“短期目标”是指 6 月 M2 的增长下降已到 9.4%的水平。这意味着从央行货币政策的角度来看，M2 的增速已经接近甚至低于“合意”的“去杠杆”目标水平，对未来的货币政策来说继续偏紧的预期有所弱化。此外，外汇占款虽然一直下降，但降幅逐月收窄，资金面在年中的关键时点上并未趋紧也是有建立在汇率小幅升值以及外汇占款净流出减缓的基础之上。因此，接下来货币政策环境对市场流动性改善有正面利好，股市流动性也将随着货币政策的“不再继续偏紧”而有所缓和。随着价值蓝筹的抱团行情，沪深 300 年初至今表现较好，但是沪深 300 当前估值水平较历史估值仍旧处于较低水平。上半年消费白马、“漂亮 50”的风格结构表现最好，然而结合基本面与估值的角度，下半年市场可能会“价值”甚至“成长”扩散，二线价值成长股可能迎来机会。此外，二季度公布的经济指标反映出经济基本面表现出一定韧性，下游需求依然强劲，但是经济基本面整体“L”型趋势仍然大概率持续。综上所述，整体股市环境中，流动性虽然预期改善乐观，但股市整体可能还是以震荡为主，难言有系统性机会。本基金依然努力在控制组合风险暴露的前提下，力争获取稳定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《德邦基金基金估值业务管理制度》、《德邦

基金估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员包括总经理、分管投资副总或投资总监、督察长、基金经理、金融工程与量化投资部、研究发展部、运作保障部负责人、基金会计及监察稽核部等相关专业人士组成。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后或基金资产在采用新投资策略和新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值委员会修订相关估值方法，以确保其持续适用。涉及估值政策的变更均须经估值委员会决议批准后执行。

在每个估值日，本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值，确定证券投资基金的份额净值。基金管理人对基金资产进行估值后，将估值结果发送基金托管人。基金托管人则按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在德邦现金宝交易型货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及基金利润分配情况等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017年6月30日 |
|-----------------|------------|---------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 3,921,196.50 |
| 结算备付金 | | 172,683.83 |
| 存出保证金 | | 101,136.43 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 64,735,493.43 |
| 其中：股票投资 | | 64,735,493.43 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | - |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - |
| 应收证券清算款 | | 175,072.55 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,990.93 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 32,917.55 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 69,140,491.22 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017年6月30日 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付证券清算款 | | 59,416.37 |
| 应付赎回款 | | 206,889.48 |
| 应付管理人报酬 | | 56,002.58 |
| 应付托管费 | | 11,200.51 |
| 应付销售服务费 | | 11,463.34 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 280,532.76 |

| | | |
|---------------|----------|---------------|
| 应交税费 | | - |
| 应付利息 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 161,048.22 |
| 负债合计 | | 786,553.26 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 64,941,591.04 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 3,412,346.92 |
| 所有者权益合计 | | 68,353,937.96 |
| 负债和所有者权益总计 | | 69,140,491.22 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，量化优选基金份额净值 1.0545 元，基金份额总额 11704519.54 份；优选 C 基金份额净值 1.0521 元，基金份额总额 53237071.5 份。德邦量化优选股票（LOF）份额总额合计为 64941591.04 份。

6.2 利润表

会计主体：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 3 月 24 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2017年3月24日(基金合同生效日)至2017 年6月30日 |
|-----------------------|------------|--|
| 一、收入 | | 3,954,318.35 |
| 1.利息收入 | | 330,439.94 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 274,502.64 |
| 债券利息收入 | | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 55,937.30 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 143,583.35 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -659,407.74 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 802,991.09 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 3,208,383.26 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |

| | | |
|----------------------------|------------|--------------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 271,911.80 |
| 减：二、费用 | | 959,180.83 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 252,995.54 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 50,599.11 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 50,584.00 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 443,682.63 |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 161,319.55 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 2,995,137.52 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 2,995,137.52 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017年3月24日（基金合同生效日）至2017年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年3月24日（基金合同生效日）至2017年6月30日 | | |
|--|--------------------------------------|--------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 201,030,406.44 | - | 201,030,406.44 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 2,995,137.52 | 2,995,137.52 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -136,088,815.40 | 417,209.40 | -135,671,606.00 |
| 其中：1.基金申购款 | 4,100,004.11 | 56,879.93 | 4,156,884.04 |
| 2.基金赎回款 | -140,188,819.51 | 360,329.47 | -139,828,490.04 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |

| | | | |
|---------------------|---------------|--------------|---------------|
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 64,941,591.04 | 3,412,346.92 | 68,353,937.96 |
|---------------------|---------------|--------------|---------------|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-----------|-----------|------------|
| <u>易强</u> | <u>易强</u> | <u>刘为臻</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1708 号文《关于准予德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册，由德邦基金管理有限公司于自 2017 年 1 月 25 日至 2017 年 3 月 16 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2017）验字第 60982868_B05 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2017 年 3 月 24 日生效。本基金为上市契约型开放式（LOF），存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 220,078,672.23 元，在募集期间产生的利息为人民币 123.96 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 220,078,796.19 元，折合 220,078,796.19 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为德邦基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券（含中小企业私募债券）、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资

基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票投资和债券投资；

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债；

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括各类应付款项。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资

产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，

同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(9) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0%的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率逐日计提;

(3) 对于 A 类基金份额,不收取基金销售服务费。对于 C 类基金份额,基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提;

(4) 卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

2、基金份额持有人可对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的,红利再投资的份额免收申购费。同一投资人在同一销售机构持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额收取销售服务费,各基金份

额类别对应的可分配收益将有所不同，在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各基金份额类别分别制定收益分配方案，本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》

的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 3,921,196.50 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 3,921,196.50 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | | |
|----|------------------------|---------------|--------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 61,527,110.17 | 64,735,493.43 | 3,208,383.26 |

| | | | |
|---------------|---------------|---------------|--------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 61,527,110.17 | 64,735,493.43 | 3,208,383.26 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,847.63 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 77.80 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 20.00 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 45.50 |
| 合计 | 1,990.93 |

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 280,532.76 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 280,532.76 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 128.67 |
| 预提费用 | 160,919.55 |
| 合计 | 161,048.22 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 量化优选 | | |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
| 项目 | 本期 2017年3月24日(基金合同生效日)至2017年6月30日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 86,793,545.80 | 86,793,545.80 |
| 本期申购 | 966,487.72 | 966,487.72 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -76,055,513.98 | -76,055,513.98 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 11,704,519.54 | 11,704,519.54 |

金额单位：人民币元

| 优选 C | | |
|------|--------------------------------------|------|
| 项目 | 本期 2017年3月24日(基金合同生效日)至2017年6月30日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日 | 114,236,860.64 | 114,236,860.64 |
| 本期申购 | 3,133,516.39 | 3,133,516.39 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -64,133,305.53 | -64,133,305.53 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 53,237,071.50 | 53,237,071.50 |

注：1、申购含红利再投、转换入金额，赎回含转换出金额。

2、基金合同于 2017 年 3 月 24 日生效。本基金为上市契约型开放式（LOF），存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 220,078,672.23 元，在募集期间产生的利息为人民币 123.96 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 220,078,796.19 元，折合 220,078,796.19 份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 量化优选 | | | |
|----------------|------------|------------|------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 86,800.92 | 617,162.94 | 703,963.86 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -72,537.88 | 6,288.91 | -66,248.97 |
| 其中：基金申购款 | -3,948.28 | 20,247.16 | 16,298.88 |
| 基金赎回款 | -68,589.60 | -13,958.25 | -82,547.85 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 14,263.04 | 623,451.85 | 637,714.89 |

单位：人民币元

| 优选 C | | | |
|----------------|-------------|--------------|--------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | -300,046.66 | 2,591,220.32 | 2,291,173.66 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 244,564.05 | 238,894.32 | 483,458.37 |
| 其中：基金申购款 | -19,176.98 | 59,758.03 | 40,581.05 |
| 基金赎回款 | 263,741.03 | 179,136.29 | 442,877.32 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -55,482.61 | 2,830,114.64 | 2,774,632.03 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---|
| | 2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 129,796.70 |
| 定期存款利息收入 | 141,555.56 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 2,876.70 |
| 其他 | 273.68 |
| 合计 | 274,502.64 |

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|---|
| | 2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额 | 133,896,906.09 |
| 减：卖出股票成本总额 | 134,556,313.83 |
| 买卖股票差价收入 | -659,407.74 |

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益—买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年3月24日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|-------------|--------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 802,991.09 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 802,991.09 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2017年3月24日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 3,208,383.26 |
| ——股票投资 | 3,208,383.26 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | 3,208,383.26 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年3月24日(基金合同生效日)至2017年 |
|----|---------------------------------|
|----|---------------------------------|

| | 6 月 30 日 |
|---------|------------|
| 基金赎回费收入 | 271,911.80 |
| 合计 | 271,911.80 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | 443,682.63 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 443,682.63 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |
|-------|--|
| 审计费用 | 31,483.98 |
| 信息披露费 | 129,435.57 |
| 其他 | 400.00 |
| 合计 | 161,319.55 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|---------------------|
| 德邦基金管理有限公司（“德邦基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”） | 基金托管人、基金代销机构 |
| 德邦证券股份有限公司（“德邦证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年3月24日(基金合同生效日)至2017年6月30日 | |
|-------|--------------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |
| 国泰君安 | 176,854,624.98 | 53.63% |
| 德邦证券 | 132,838,809.59 | 40.28% |

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年3月24日(基金合同生效日)至2017年6月30日 | |
|-------|--------------------------------------|--------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 |
| 国泰君安 | 149,000,000.00 | 100.00% |

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年3月24日(基金合同生效日)至2017年6月30日 | | | |
|-------|--------------------------------------|------------|------------|--------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 国泰君安 | 164,704.10 | 58.71% | 164,704.10 | 58.71% |
| 德邦证券 | 97,144.46 | 34.63% | 97,144.46 | 34.63% |

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年3月24日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,058.20 |

注：支付基金管理人德邦基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.0% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年3月24日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|----|--------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的托管费 |

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2017年3月24日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|----------------|--------------------------------------|
| | |

| | 量化优选 | 优选 C | 合计 |
|------|------|-----------|-----------|
| 德邦基金 | - | 49,975.58 | 49,975.58 |
| 合计 | - | 49,975.58 | 49,975.58 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。销售服务费的计算方式如下：

$$H = E * 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 量化优选 | |
|------------|------------------------|----------------------|
| | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | |
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比例 |
| 德邦证券股份有限公司 | 2,301,520.00 | 3.5400% |

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方 名称 | 本期 2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 | |
|-----------|---|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 国泰君安 | 3,921,196.50 | 129,796.70 |

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间获得的利息收入为人民币 2,876.70 元，2017 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 172,683.83 元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期未发生其它关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 603933 | 睿能科技 | 2017年6月28日 | 2017年7月6日 | 新股流通受限 | 20.20 | 20.20 | 857 | 17,311.40 | 17,311.40 | - |
| 603305 | 旭升股份 | 2017年6月30日 | 2017年7月10日 | 新股流通受限 | 11.26 | 11.26 | 1,193 | 13,433.18 | 13,433.18 | - |
| 603331 | 百达精工 | 2017年6月27日 | 2017年7月5日 | 新股流通受限 | 9.63 | 9.63 | 787 | 7,578.81 | 7,578.81 | - |
| 603617 | 君禾股份 | 2017年6月23日 | 2017年7月3日 | 新股流通受限 | 8.93 | 8.93 | 832 | 7,429.76 | 7,429.76 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|-----------|------|--------|------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 002447 | 壹桥股份 | 2017年5月2日 | 重大事 | 9.00 | - | - | 114,800 | 1,130,439.10 | 1,033,200.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|--------|-------|---|---|--------|------------|------------|---|
| | | 日 | 项 | | | | | | | |
| 000662 | 天夏智慧 | 2017年6月5日 | 重大资产重组 | 16.00 | - | - | 48,900 | 784,062.00 | 782,400.00 | - |
| 300089 | 文化长城 | 2017年4月19日 | 重大事项 | 14.93 | - | - | 29,755 | 477,712.82 | 444,242.15 | - |
| 002621 | 三垒股份 | 2017年5月9日 | 重大事项 | 15.19 | - | - | 11,550 | 160,469.54 | 175,444.50 | - |
| 601989 | 中国重工 | 2017年5月31日 | 重大事项 | 6.21 | - | - | 20,000 | 125,600.00 | 124,200.00 | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理、全员风险管理，公司构建了分工明确、相互协作、彼此制约的风险管理组织架构体系。董事会负责公司整体经营风险的管理，对公司建立风险管理体系和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，协助董事会进行风险管理，风险管理

委员会负责起草公司风险管理战略，审议、监督、检查、评估公司经营管理与受托投资的风险控制状况。经理层负责落实董事会拟定的风险管理政策，并对风险控制的有效执行承担责任。经理层下设风险控制委员会，协助经理层进行风险控制，风险控制委员会负责组织风险管理体系的建设，确定风险管理原则、目标和方法，审议风险管理制度和流程，指导重大风险事件的处理。督察长负责监督检查公司风险管理工作的执行情况，评价公司内部风险控制制度的合法性、合规性和有效性，并向董事会报告。监察稽核部门为日常风险管理的执行部门，主要负责对公司经营管理和受托投资风险的预警和事中控制，对有关风险进行分析并向经理层汇报。公司各部门是风险控制措施的执行部门，负责识别和控制业务活动中潜在风险，做好风险的事先防范。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

6.4.12.5 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.12.6 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

6.4.12.7 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.7.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

6.4.12.7.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2017年6月30日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|--------------|-------|--------|------|------|----------------|---------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 3,921,196.50 | - | - | - | - | - | 3,921,196.50 |
| 结算备付金 | 172,683.83 | - | - | - | - | - | 172,683.83 |
| 存出保证金 | 101,136.43 | - | - | - | - | - | 101,136.43 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 64,735,493.43 | 64,735,493.43 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 175,072.55 | 175,072.55 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,990.93 | 1,990.93 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 32,917.55 | 32,917.55 |
| 资产总计 | 4,195,016.76 | - | - | - | - | 64,945,474.46 | 69,140,491.22 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 59,416.37 | 59,416.37 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 207,018.15 | 207,018.15 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 56,002.58 | 56,002.58 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 11,200.51 | 11,200.51 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 11,463.34 | 11,463.34 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 280,532.76 | 280,532.76 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 160,919.55 | 160,919.55 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 786,553.26 | 786,553.26 |
| 利率敏感度缺口 | 4,195,016.76 | - | - | - | - | -64,158,921.20 | 68,353,937.96 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.12.7.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资。银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.12.7.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.7.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

6.4.12.7.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | |
|---------------|------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 64,735,493.43 | 94.71 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | - | - |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 64,735,493.43 | 94.71 |

注：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0-95%，投资于债券、债券回购、货币市场工具、现金、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的 5%；每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.12.7.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | |
|----|--|
| 假设 | 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金所投资证券的贝塔系数紧密相关； |
| | 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。 |

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） |
|----|----------------|---------------------------------|
| | | 本期末（2017年6月30日） |
| | 沪深 300 指数下跌 1% | -536,719.02 |
| | 沪深 300 指数上涨 1% | 536,719.02 |

注：本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 64,735,493.43 | 93.63 |
| | 其中：股票 | 64,735,493.43 | 93.63 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,093,880.33 | 5.92 |
| 7 | 其他各项资产 | 311,117.46 | 0.45 |
| 8 | 合计 | 69,140,491.22 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,033,200.00 | 1.51 |
| B | 采矿业 | 3,101,084.00 | 4.54 |
| C | 制造业 | 29,676,004.77 | 43.42 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,803,167.00 | 7.03 |
| E | 建筑业 | 2,785,674.36 | 4.08 |
| F | 批发和零售业 | 2,090,408.50 | 3.06 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,981,415.00 | 2.90 |
| H | 住宿和餐饮业 | 132,790.00 | 0.19 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 207,015.00 | 0.30 |
| J | 金融业 | 16,886,327.80 | 24.70 |
| K | 房地产业 | 1,877,315.00 | 2.75 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业 | 53,720.00 | 0.08 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 107,372.00 | 0.16 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 64,735,493.43 | 94.71 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 39,500 | 1,959,595.00 | 2.87 |
| 2 | 600816 | 安信信托 | 130,200 | 1,769,418.00 | 2.59 |
| 3 | 601818 | 光大银行 | 431,600 | 1,747,980.00 | 2.56 |
| 4 | 600859 | 王府井 | 106,190 | 1,714,968.50 | 2.51 |
| 5 | 600567 | 山鹰纸业 | 475,500 | 1,702,290.00 | 2.49 |
| 6 | 600741 | 华域汽车 | 67,500 | 1,636,200.00 | 2.39 |
| 7 | 600674 | 川投能源 | 166,000 | 1,630,120.00 | 2.38 |
| 8 | 601288 | 农业银行 | 462,200 | 1,626,944.00 | 2.38 |
| 9 | 600031 | 三一重工 | 198,000 | 1,609,740.00 | 2.36 |
| 10 | 600383 | 金地集团 | 138,500 | 1,588,595.00 | 2.32 |
| 11 | 600170 | 上海建工 | 407,148 | 1,555,305.36 | 2.28 |
| 12 | 600507 | 方大特钢 | 182,000 | 1,552,460.00 | 2.27 |
| 13 | 600886 | 国投电力 | 195,100 | 1,541,290.00 | 2.25 |
| 14 | 601636 | 旗滨集团 | 329,900 | 1,487,849.00 | 2.18 |
| 15 | 601998 | 中信银行 | 227,200 | 1,429,088.00 | 2.09 |
| 16 | 601939 | 建设银行 | 229,000 | 1,408,350.00 | 2.06 |
| 17 | 600681 | 百川能源 | 98,900 | 1,395,479.00 | 2.04 |
| 18 | 601233 | 桐昆股份 | 100,300 | 1,390,158.00 | 2.03 |
| 19 | 600837 | 海通证券 | 92,200 | 1,369,170.00 | 2.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 20 | 600030 | 中信证券 | 80,200 | 1,365,004.00 | 2.00 |
| 21 | 600312 | 平高电气 | 94,200 | 1,294,308.00 | 1.89 |
| 22 | 600348 | 阳泉煤业 | 178,700 | 1,211,586.00 | 1.77 |
| 23 | 601699 | 潞安环能 | 154,400 | 1,207,408.00 | 1.77 |
| 24 | 600983 | 惠而浦 | 107,900 | 1,167,478.00 | 1.71 |
| 25 | 600160 | 巨化股份 | 96,700 | 1,163,301.00 | 1.70 |
| 26 | 600585 | 海螺水泥 | 50,100 | 1,138,773.00 | 1.67 |
| 27 | 600377 | 宁沪高速 | 115,000 | 1,127,000.00 | 1.65 |
| 28 | 600104 | 上汽集团 | 35,300 | 1,096,065.00 | 1.60 |
| 29 | 600519 | 贵州茅台 | 2,300 | 1,085,255.00 | 1.59 |
| 30 | 600161 | 天坛生物 | 26,826 | 1,041,117.06 | 1.52 |
| 31 | 601100 | 恒立液压 | 63,500 | 1,034,415.00 | 1.51 |
| 32 | 002447 | 壹桥股份 | 114,800 | 1,033,200.00 | 1.51 |
| 33 | 600118 | 中国卫星 | 36,400 | 1,013,376.00 | 1.48 |
| 34 | 601668 | 中国建筑 | 102,300 | 990,264.00 | 1.45 |
| 35 | 600019 | 宝钢股份 | 143,500 | 962,885.00 | 1.41 |
| 36 | 601601 | 中国太保 | 28,100 | 951,747.00 | 1.39 |
| 37 | 600015 | 华夏银行 | 102,240 | 942,652.80 | 1.38 |
| 38 | 600409 | 三友化工 | 88,700 | 893,209.00 | 1.31 |
| 39 | 601058 | 赛轮金宇 | 248,900 | 851,238.00 | 1.25 |
| 40 | 000662 | 天夏智慧 | 48,900 | 782,400.00 | 1.14 |
| 41 | 600346 | 恒力股份 | 94,800 | 777,360.00 | 1.14 |
| 42 | 601398 | 工商银行 | 136,000 | 714,000.00 | 1.04 |
| 43 | 601009 | 南京银行 | 61,200 | 686,052.00 | 1.00 |
| 44 | 601899 | 紫金矿业 | 188,600 | 646,898.00 | 0.95 |
| 45 | 601600 | 中国铝业 | 142,000 | 641,840.00 | 0.94 |
| 46 | 600809 | 山西汾酒 | 17,500 | 607,075.00 | 0.89 |
| 47 | 600309 | 万华化学 | 18,900 | 541,296.00 | 0.79 |
| 48 | 600894 | 广日股份 | 44,800 | 530,432.00 | 0.78 |
| 49 | 600529 | 山东药玻 | 20,100 | 493,857.00 | 0.72 |
| 50 | 601169 | 北京银行 | 53,100 | 486,927.00 | 0.71 |
| 51 | 601006 | 大秦铁路 | 56,900 | 477,391.00 | 0.70 |
| 52 | 300089 | 文化长城 | 29,755 | 444,242.15 | 0.65 |
| 53 | 600705 | 中航资本 | 76,000 | 429,400.00 | 0.63 |
| 54 | 600703 | 三安光电 | 19,600 | 386,120.00 | 0.56 |
| 55 | 601607 | 上海医药 | 13,000 | 375,440.00 | 0.55 |
| 56 | 600269 | 赣粤高速 | 51,800 | 269,878.00 | 0.39 |
| 57 | 600963 | 岳阳林纸 | 34,100 | 256,773.00 | 0.38 |
| 58 | 600325 | 华发股份 | 25,200 | 210,420.00 | 0.31 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 59 | 600900 | 长江电力 | 13,300 | 204,554.00 | 0.30 |
| 60 | 601669 | 中国电建 | 25,000 | 198,000.00 | 0.29 |
| 61 | 600566 | 济川药业 | 5,200 | 197,756.00 | 0.29 |
| 62 | 002621 | 三垒股份 | 11,550 | 175,444.50 | 0.26 |
| 63 | 600801 | 华新水泥 | 17,800 | 169,634.00 | 0.25 |
| 64 | 600479 | 千金药业 | 10,900 | 157,723.00 | 0.23 |
| 65 | 603288 | 海天味业 | 3,800 | 154,964.00 | 0.23 |
| 66 | 600110 | 诺德股份 | 9,500 | 133,855.00 | 0.20 |
| 67 | 600754 | 锦江股份 | 4,900 | 132,790.00 | 0.19 |
| 68 | 600285 | 羚锐制药 | 11,600 | 130,268.00 | 0.19 |
| 69 | 601989 | 中国重工 | 20,000 | 124,200.00 | 0.18 |
| 70 | 601566 | 九牧王 | 7,000 | 112,840.00 | 0.17 |
| 71 | 300451 | 创业软件 | 3,700 | 112,406.00 | 0.16 |
| 72 | 600885 | 宏发股份 | 2,700 | 107,703.00 | 0.16 |
| 73 | 600551 | 时代出版 | 6,800 | 107,372.00 | 0.16 |
| 74 | 600018 | 上港集团 | 16,900 | 107,146.00 | 0.16 |
| 75 | 600664 | 哈药股份 | 17,400 | 101,094.00 | 0.15 |
| 76 | 002555 | 三七互娱 | 3,700 | 94,609.00 | 0.14 |
| 77 | 601012 | 隆基股份 | 4,900 | 83,790.00 | 0.12 |
| 78 | 600208 | 新湖中宝 | 17,400 | 78,300.00 | 0.11 |
| 79 | 600873 | 梅花生物 | 13,500 | 76,545.00 | 0.11 |
| 80 | 600093 | 易见股份 | 4,000 | 53,720.00 | 0.08 |
| 81 | 600487 | 亨通光电 | 1,800 | 50,490.00 | 0.07 |
| 82 | 601186 | 中国铁建 | 3,500 | 42,105.00 | 0.06 |
| 83 | 600329 | 中新药业 | 2,300 | 41,653.00 | 0.06 |
| 84 | 000568 | 泸州老窖 | 800 | 40,464.00 | 0.06 |
| 85 | 603801 | 志邦股份 | 1,171 | 39,579.80 | 0.06 |
| 86 | 600761 | 安徽合力 | 2,800 | 36,680.00 | 0.05 |
| 87 | 600711 | 盛屯矿业 | 5,300 | 35,192.00 | 0.05 |
| 88 | 603335 | 迪生力 | 3,124 | 34,832.60 | 0.05 |
| 89 | 600461 | 洪城水业 | 4,400 | 31,724.00 | 0.05 |
| 90 | 603043 | 广州酒家 | 923 | 23,324.21 | 0.03 |
| 91 | 603679 | 华体科技 | 809 | 21,438.50 | 0.03 |
| 92 | 603938 | 三孚股份 | 1,246 | 20,932.80 | 0.03 |
| 93 | 603933 | 睿能科技 | 857 | 17,311.40 | 0.03 |
| 94 | 603286 | 日盈电子 | 890 | 13,528.00 | 0.02 |
| 95 | 603305 | 旭升股份 | 1,193 | 13,433.18 | 0.02 |
| 96 | 603331 | 百达精工 | 787 | 7,578.81 | 0.01 |
| 97 | 603617 | 君禾股份 | 832 | 7,429.76 | 0.01 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 601233 | 桐昆股份 | 3,786,405.00 | 5.54 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 3,780,999.39 | 5.53 |
| 3 | 601006 | 大秦铁路 | 3,338,803.00 | 4.88 |
| 4 | 600507 | 方大特钢 | 3,106,018.00 | 4.54 |
| 5 | 000776 | 广发证券 | 3,079,602.00 | 4.51 |
| 6 | 600566 | 济川药业 | 3,041,168.03 | 4.45 |
| 7 | 601009 | 南京银行 | 2,989,619.68 | 4.37 |
| 8 | 600104 | 上汽集团 | 2,932,712.12 | 4.29 |
| 9 | 601939 | 建设银行 | 2,924,985.00 | 4.28 |
| 10 | 601818 | 光大银行 | 2,846,064.00 | 4.16 |
| 11 | 002503 | 搜于特 | 2,832,932.80 | 4.14 |
| 12 | 600585 | 海螺水泥 | 2,790,501.65 | 4.08 |
| 13 | 600837 | 海通证券 | 2,720,600.76 | 3.98 |
| 14 | 600519 | 贵州茅台 | 2,698,188.12 | 3.95 |
| 15 | 600036 | 招商银行 | 2,657,979.81 | 3.89 |
| 16 | 600019 | 宝钢股份 | 2,636,255.00 | 3.86 |
| 17 | 600170 | 上海建工 | 2,612,151.17 | 3.82 |
| 18 | 601998 | 中信银行 | 2,587,473.86 | 3.79 |
| 19 | 601607 | 上海医药 | 2,544,601.40 | 3.72 |
| 20 | 600161 | 天坛生物 | 2,467,778.96 | 3.61 |
| 21 | 600383 | 金地集团 | 2,427,662.00 | 3.55 |
| 22 | 600816 | 安信信托 | 2,420,494.45 | 3.54 |
| 23 | 600487 | 亨通光电 | 2,419,345.00 | 3.54 |
| 24 | 600567 | 山鹰纸业 | 2,353,321.00 | 3.44 |
| 25 | 300115 | 长盈精密 | 2,313,371.00 | 3.38 |
| 26 | 600031 | 三一重工 | 2,312,674.00 | 3.38 |
| 27 | 000338 | 潍柴动力 | 2,182,126.00 | 3.19 |
| 28 | 601699 | 潞安环能 | 2,092,513.00 | 3.06 |
| 29 | 300401 | 花园生物 | 2,066,107.00 | 3.02 |
| 30 | 601601 | 中国太保 | 2,064,002.00 | 3.02 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 31 | 600859 | 王府井 | 2,056,570.47 | 3.01 |
| 32 | 600681 | 百川能源 | 2,048,967.00 | 3.00 |
| 33 | 600886 | 国投电力 | 2,043,053.39 | 2.99 |
| 34 | 600900 | 长江电力 | 2,001,262.50 | 2.93 |
| 35 | 002092 | 中泰化学 | 1,993,585.78 | 2.92 |
| 36 | 600983 | 惠而浦 | 1,984,182.00 | 2.90 |
| 37 | 600258 | 首旅酒店 | 1,941,943.40 | 2.84 |
| 38 | 600809 | 山西汾酒 | 1,939,532.00 | 2.84 |
| 39 | 600741 | 华域汽车 | 1,913,298.78 | 2.80 |
| 40 | 600674 | 川投能源 | 1,911,798.00 | 2.80 |
| 41 | 600312 | 平高电气 | 1,908,905.00 | 2.79 |
| 42 | 300089 | 文化长城 | 1,874,193.80 | 2.74 |
| 43 | 000400 | 许继电气 | 1,860,479.25 | 2.72 |
| 44 | 300072 | 三聚环保 | 1,858,538.00 | 2.72 |
| 45 | 600479 | 千金药业 | 1,849,481.60 | 2.71 |
| 46 | 600452 | 涪陵电力 | 1,841,640.60 | 2.69 |
| 47 | 601668 | 中国建筑 | 1,835,985.00 | 2.69 |
| 48 | 002142 | 宁波银行 | 1,823,714.89 | 2.67 |
| 49 | 600409 | 三友化工 | 1,807,286.40 | 2.64 |
| 50 | 000333 | 美的集团 | 1,768,201.00 | 2.59 |
| 51 | 601801 | 皖新传媒 | 1,625,195.00 | 2.38 |
| 52 | 601288 | 农业银行 | 1,598,402.00 | 2.34 |
| 53 | 000429 | 粤高速 A | 1,576,749.51 | 2.31 |
| 54 | 600030 | 中信证券 | 1,569,518.00 | 2.30 |
| 55 | 601100 | 恒立液压 | 1,565,627.00 | 2.29 |
| 56 | 002611 | 东方精工 | 1,562,808.00 | 2.29 |
| 57 | 601688 | 华泰证券 | 1,517,187.00 | 2.22 |
| 58 | 600348 | 阳泉煤业 | 1,509,201.00 | 2.21 |
| 59 | 601636 | 旗滨集团 | 1,501,754.00 | 2.20 |
| 60 | 601058 | 赛轮金宇 | 1,490,817.00 | 2.18 |
| 61 | 600338 | 西藏珠峰 | 1,446,787.06 | 2.12 |
| 62 | 002143 | 印纪传媒 | 1,410,777.00 | 2.06 |
| 63 | 002447 | 壹桥股份 | 1,389,416.00 | 2.03 |

注：买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|--------------|----------------|
| 1 | 601006 | 大秦铁路 | 2,975,365.20 | 4.35 |
| 2 | 600566 | 济川药业 | 2,919,512.04 | 4.27 |
| 3 | 000776 | 广发证券 | 2,911,902.00 | 4.26 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 2,901,196.51 | 4.24 |
| 5 | 002503 | 搜于特 | 2,855,005.19 | 4.18 |
| 6 | 601607 | 上海医药 | 2,502,802.44 | 3.66 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 2,449,025.00 | 3.58 |
| 8 | 600487 | 亨通光电 | 2,357,245.00 | 3.45 |
| 9 | 601233 | 桐昆股份 | 2,323,291.90 | 3.40 |
| 10 | 300115 | 长盈精密 | 2,314,084.04 | 3.39 |
| 11 | 600104 | 上汽集团 | 2,297,351.00 | 3.36 |
| 12 | 601009 | 南京银行 | 2,154,856.56 | 3.15 |
| 13 | 000338 | 潍柴动力 | 2,137,509.48 | 3.13 |
| 14 | 600519 | 贵州茅台 | 2,054,725.60 | 3.01 |
| 15 | 300401 | 花园生物 | 2,027,620.00 | 2.97 |
| 16 | 600900 | 长江电力 | 1,960,002.00 | 2.87 |
| 17 | 002092 | 中泰化学 | 1,902,249.00 | 2.78 |
| 18 | 000333 | 美的集团 | 1,881,076.00 | 2.75 |
| 19 | 300072 | 三聚环保 | 1,827,819.00 | 2.67 |
| 20 | 000429 | 粤高速 A | 1,808,648.94 | 2.65 |
| 21 | 600507 | 方大特钢 | 1,800,805.00 | 2.63 |
| 22 | 002142 | 宁波银行 | 1,763,190.34 | 2.58 |
| 23 | 600479 | 千金药业 | 1,746,302.00 | 2.55 |
| 24 | 600258 | 首旅酒店 | 1,720,831.20 | 2.52 |
| 25 | 600585 | 海螺水泥 | 1,670,634.77 | 2.44 |
| 26 | 600019 | 宝钢股份 | 1,661,255.16 | 2.43 |
| 27 | 000400 | 许继电气 | 1,646,176.13 | 2.41 |
| 28 | 601939 | 建设银行 | 1,603,495.00 | 2.35 |
| 29 | 600452 | 涪陵电力 | 1,592,613.14 | 2.33 |
| 30 | 601688 | 华泰证券 | 1,575,347.00 | 2.30 |
| 31 | 600161 | 天坛生物 | 1,511,997.00 | 2.21 |
| 32 | 601601 | 中国太保 | 1,510,909.00 | 2.21 |
| 33 | 600338 | 西藏珠峰 | 1,461,915.00 | 2.14 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 34 | 600809 | 山西汾酒 | 1,447,511.00 | 2.12 |
| 35 | 600837 | 海通证券 | 1,418,609.00 | 2.08 |
| 36 | 002143 | 印纪传媒 | 1,403,023.00 | 2.05 |
| 37 | 601801 | 皖新传媒 | 1,367,879.88 | 2.00 |

注：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 196,083,424.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 133,896,906.09 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 101,136.43 |
| 2 | 应收证券清算款 | 175,072.55 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,990.93 |
| 5 | 应收申购款 | 32,917.55 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 311,117.46 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|------|-----------|------------|---------------|--------|--------------|--------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 量化优选 | 524 | 22,336.87 | 10,303,853.00 | 88.03% | 1,400,666.54 | 11.97% |
| 优选 C | 130 | 409,515.93 | 51,975,182.94 | 97.63% | 1,261,888.56 | 2.37% |
| 合计 | 654 | 99,299.07 | 62,279,035.94 | 95.90% | 2,662,555.10 | 4.10% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 量化优选 | 2,000.52 | 0.0171% |
| | 优选 C | 101,080.31 | 0.1899% |
| | 合计 | 103,080.83 | 0.1587% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 量化优选 | 0 |
| | 优选 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 量化优选 | 0 |
| | 优选 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 量化优选 | 优选 C |
|------------------------------------|---------------|----------------|
| 基金合同生效日（2017 年 3 月 24 日）基金份额总额 | 86,793,545.80 | 114,236,860.64 |
| 本报告期期初基金份额总额 | - | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 966,487.72 | 3,133,516.39 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 76,055,513.98 | 64,133,305.53 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 11,704,519.54 | 53,237,071.50 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘其审计的会计师事务所。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自基金合同生效日起至本报告期末，向本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

本报告期内，由于对下属机构管控原因，中国证监会上海监管局对基金管理人相关高级管理人员采取出具警示函的监督管理措施，相关高级管理人员已积极进行整改。除上述内容外，基金管理人及其他高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|-------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| | | | | | | |

| | | | 例 | | | |
|--------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 国泰君安证券 | 2 | 176,854,624.98 | 53.63% | 164,704.10 | 58.71% | - |
| 德邦证券 | 2 | 132,838,809.59 | 40.28% | 97,144.46 | 34.63% | - |
| 兴业证券 | 2 | 20,062,735.72 | 6.08% | 18,684.20 | 6.66% | - |

注：1、公司选择基金专用交易席位的基本选择标准：

- （一）注册资本不低于 1 亿元人民币；
- （二）财务状况良好，各项风险监控指标符合证监会的相关规定；
- （三）经营行为规范，未就交易单元发生违约或侵权行为；
- （四）内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足投资组合资产运作高度保密的要求；
- （五）具备高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理各投资组合进行证券交易的需要；
- （六）研究实力较强，能根据需求提供质量较高的研究报告，以及相应的信息咨询服务；
- （七）收取的佣金费率合理。

公司按如下流程选择租用交易单元的证券公司：

- （一）研究部按照上述选择标准对证券公司进行初步筛选，经投资总监批准后提请总经理审批；
- （二）交易部办理相关交易单元，信息技术部、基金事务部和监察稽核部等相关部门配合完成交易单元租用的技术准备、参数调整及合同签订并及时通知各投资组合的托管机构等事宜。

2、本报告期内，本基金新增租用德邦证券、兴业证券的交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|--------|------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国泰君安证券 | - | - | 149,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|----------------|-----------------|
| 1 | 德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）发售法律文件 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 1 月 20 日 |
| 2 | 德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）上网发售提示性公告 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 1 月 25 日 |
| 3 | 德邦基金管理有限公司关于德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）增加华泰证券为代销机构的公告 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 2 月 20 日 |
| 4 | 德邦基金管理有限公司关于旗下基金增加宜信普泽为代销机构并开通定期定额申购业务、基金转换业务及参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 2 月 20 日 |
| 5 | 德邦基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 2 月 23 日 |
| 6 | 德邦基金管理有限公司关于调整德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）最低认、申购限额及追加认、申购最低金额的公告 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 2 月 24 日 |
| 7 | 德邦基金管理有限公司关于德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）增加海通证券为代销机构的公告 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 3 月 9 日 |
| 8 | 德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）提前结束募集的公告 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 3 月 17 日 |
| 9 | 德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）基金合同生效公告 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 3 月 27 日 |
| 10 | 德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回业务的公告 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 3 月 28 日 |
| 11 | 德邦基金管理有限公司关于德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）开展赎回费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 3 月 29 日 |
| 12 | 德邦基金管理有限公司关于 | 中国证监会指定媒 | 2017 年 3 月 30 日 |

| | | | |
|----|---|----------------|-----------------|
| | 德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）增加民生银行为代销机构的公告 | 体及公司网站 | |
| 13 | 德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海汇付为代销机构并开通定期定额申购业务、基金转换业务及参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 3 月 30 日 |
| 14 | 德邦基金管理有限公司关于旗下基金增加东莞证券为代销机构并开通定期定额申购业务、基金转换业务的公告 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 4 月 7 日 |
| 15 | 德邦基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定媒体及公司网站 | 2017 年 4 月 22 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|-------|----------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20170414-20170518 | 20,007,200.00 | 0.00 | 20,007,200.00 | 0.00 | 0.00% |
| | 2 | 20170414-20170630 | 20,006,300.00 | 0.00 | 0.00 | 20,006,300.00 | 30.81% |
| | 3 | 20170531-20170630 | 15,004,725.00 | 0.00 | 0.00 | 15,004,725.00 | 23.10% |
| | 4 | 20170320-20170322 | 0.00 | 40,011,600.00 | 40,011,600.00 | 0.00 | 0.00% |

产品特有风险

- 1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；
- 2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- 3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；
- 4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- 5、单一机构投资者赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；
- 6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；
- 7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）基金合同；
- 3、德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）基金托管协议；
- 4、德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内按照规定披露的各项公告。

12.2 存放地点

上海市虹口区吴淞路 218 号宝矿国际大厦 35 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件，亦可通过公司网站查询，公司网址为 www.dbfund.com.cn。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-821-7788

德邦基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日